

DWS Investment GmbH

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Halbjahresbericht 2021/2022



FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Inhalt

Halbjahresbericht 2021/2022
vom 1.10.2021 bis 31.3.2022 (gemäß § 103 KAGB)

Hinweise 2

Halbjahresbericht
FOS Strategie-Fonds Nr. 1 6

Hinweise

Wertentwicklung

Der Erfolg einer Investmentfondsanlage wird an der Wertentwicklung der Anteile gemessen. Als Basis für die Wertberechnung werden die Anteilwerte (=Rücknahmepreise) herangezogen, unter Hinzurechnung zwischenzeitlicher Ausschüttungen, die z.B. im Rahmen der Investmentkonten bei der DWS Investment GmbH kostenfrei reinvestiert werden; bei inländischen thesaurierenden Fonds wird die – nach etwaiger Anrechnung ausländischer Quellensteuer – vom Fonds erhobene inländische Kapitalertragsteuer zuzüglich Solidaritätszuschlag hinzuge-rechnet. Die Berechnung der Wertentwicklung erfolgt nach der BVI-Methode. Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognosen für die Zukunft.

Darüber hinaus sind in den Berichten auch die entsprechenden Vergleichsindizes – soweit vorhanden – dargestellt. Alle Grafik- und Zahlenangaben geben den **Stand vom 31. März 2022** wieder (sofern nichts anderes angegeben ist).

Verkaufsprospekte

Alleinverbindliche Grundlage des Kaufs ist der aktuelle Verkaufsprospekt einschließlich Anlagebedingungen sowie das Dokument „Wesentliche Anlegerinformationen“, die Sie bei der DWS Investment GmbH oder den Geschäftsstellen der Deutsche Bank AG und weiteren Zahlstellen erhalten.

Angaben zur Kostenpauschale

In der Kostenpauschale sind folgende Aufwendungen nicht enthalten:

- a) im Zusammenhang mit dem Erwerb und der Veräußerung von Vermögensgegenständen entstehende Kosten;
- b) im Zusammenhang mit den Kosten der Verwaltung und Verwahrung evtl. entstehende Steuern;
- c) Kosten für die Geltendmachung und Durchsetzung von Rechtsansprüchen des Sondervermögens.

Details zur Vergütungsstruktur sind im aktuellen Verkaufsprospekt geregelt.

Ausgabe- und Rücknahmepreise

Börsentäglich im Internet
www.dws.de

Russland/Ukraine-Krise

Der eskalierende Konflikt zwischen Russland und der Ukraine markiert einen dramatischen Wendepunkt in Europa, der unter anderem die Sicherheitsarchitektur und die Energiepolitik Europas nachhaltig beeinflussen und für erhebliche Volatilität sorgen dürfte. Allerdings sind die konkreten bzw. möglichen mittel- bis langfristigen Auswirkungen der Krise auf die Konjunktur, einzelne Märkte und Branchen sowie die sozialen Implikationen angesichts der Unsicherheit zum Zeitpunkt der Aufstellung des vorliegenden Berichts nicht abschließend beurteilbar. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft des Sondervermögens setzt deshalb ihre Bemühungen im Rahmen ihres Risikomanagements fort, um diese Unsicherheiten bewerten und ihren möglichen Auswirkungen auf die Aktivitäten, die Liquidität und die Wertentwicklung des Sondervermögens begegnen zu können. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft ergreift alle als angemessen erachteten Maßnahmen, um die Anlegerinteressen bestmöglich zu schützen.

Coronakrise

Seit Januar 2020 hat sich das Coronavirus ausgebreitet und in der Folgezeit zu einer ernsten, wirtschaftlichen Krise geführt. Die dynamische Ausbreitung des Virus schlug sich mitunter in erheblichen Marktverwerfungen bei zugleich deutlich gestiegenen Volatilitäten nieder. Beschränkungen der Bewegungsfreiheit, wiederholte Lockdown-Maßnahmen, Produktionsstopps sowie unterbrochene Lieferketten übten großen Druck auf nachgelagerte wirtschaftliche Prozesse aus, so dass sich die weltweiten Konjunkturperspektiven erheblich eintrübten. An den Märkten waren zwischenzeitlich – u.a. durch Hilfsprogramme im Rahmen der Geld- und Fiskalpolitik sowie umfassende Impf- und Testkampagnen – zwar spürbare Erholungen und teils neue Höchststände zu beobachten. Dennoch sind die konkreten bzw. möglichen mittel- bis langfristigen Auswirkungen der Krise auf die Konjunktur, einzelne Märkte und Branchen sowie die sozialen Implikationen angesichts der Dynamik der globalen Ausbreitung des Virus bzw. des Auftretens diverser Mutationen und des damit einhergehenden hohen Grads an Unsicherheit zum Zeitpunkt der Aufstellung des vorliegenden Berichts nicht verlässlich beurteilbar. Somit kann es weiterhin zu einer wesentlichen Beeinflussung des jeweiligen Sondervermögens kommen. Ein bedeutendes Maß an Unsicherheit besteht hinsichtlich der finanziellen Auswirkungen der Pandemie, da diese von externen Faktoren wie etwa der Verbreitung des Virus sowie dessen Varianten und den von den einzelnen Regierungen und Zentralbanken ergriffenen Maßnahmen, der erfolgreichen Eindämmung der Entwicklung der Infektionsraten in Verbindung mit den Impfquoten und dem zügigen und nachhaltigen Wiederanlaufen der Konjunktur abhängig sind.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft des Sondervermögens setzt deshalb ihre Bemühungen im Rahmen ihres Risikomanagements fort, um diese Unsicherheiten bewerten und ihren möglichen Auswirkungen auf die Aktivitäten, die Liquidität und die Wertentwicklung des Sondervermögens begegnen zu können. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft ergreift alle als angemessen erachteten Maßnahmen, um die Anlegerinteressen bestmöglich zu schützen. In Abstimmung mit den Dienstleistern hat die Kapitalverwaltungsgesellschaft die Folgen der Coronakrise beobachtet und deren Auswirkungen auf das Sondervermögen und die Märkte, in denen dieses investiert, angemessen in ihre Entscheidungsfindung einbezogen. Zum Datum des vorliegenden Berichts wurden dem Sondervermögen gegenüber keine bedeutenden Rücknahmeanträge gestellt; Auswirkungen auf dessen Anteilscheingeschäft werden von der Kapitalverwaltungsgesellschaft kontinuierlich überwacht; die Leistungsfähigkeit der wichtigsten Dienstleister hat keine wesentlichen Beeinträchtigungen erfahren. In diesem Zusammenhang hat sich die Kapitalverwaltungsgesellschaft des Sondervermögens im Einklang mit zahlreichen nationalen Leitlinien nach Gesprächen mit den wichtigsten Dienstleistern (insbesondere hinsichtlich Verwahrstelle, Portfoliomanagement und Fondsadministration) davon überzeugt, dass die getroffenen Maßnahmen und Pläne zur Sicherstellung der Fortführung des Geschäftsbetriebs (u.a. umfangreiche Hygienemaßnahmen in den Räumlichkeiten, Einschränkungen bei Geschäftsreisen und Veranstaltungen, Vorkehrungen zur Gewährleistung eines verlässlichen und reibungslosen Ablaufs der Geschäftsprozesse bei Verdachtsfall auf eine Coronavirus-Infektion, Ausweitung der technischen Möglichkeiten zum mobilen Arbeiten) die derzeit absehbaren bzw. laufenden operativen Risiken eindämmen und gewährleisten, dass die Tätigkeiten des Sondervermögens nicht unterbrochen werden.

Zum Zeitpunkt der Aufstellung des vorliegenden Berichts liegen nach Auffassung der Kapitalverwaltungsgesellschaft weder Anzeichen vor, die gegen die Fortführung des Sondervermögens sprechen, noch ergaben sich für das Sondervermögen Liquiditätsprobleme.

Halbjahresbericht

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

FOS STRATEGIE-FONDS NR. 1

Wertentwicklung im Überblick

ISIN	6 Monate
DE000DWS0TS9	-2,5%

Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages.
Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft.

Stand: 31.3.2022
Angaben auf Euro-Basis

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Vermögensübersicht zum 31.03.2022

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien (Branchen):		
Dauerhafte Konsumgüter	31 933 859,12	8,39
Industrien	22 040 123,86	5,79
Finanzsektor	20 552 475,38	5,40
Versorger	17 845 977,79	4,69
Hauptverbrauchsgüter	16 490 056,71	4,33
Grundstoffe	16 435 219,87	4,32
Gesundheitswesen	16 143 919,97	4,24
Informationstechnologie	13 955 604,63	3,67
Kommunikationsdienste	11 165 643,00	2,94
Energie	9 788 725,00	2,57
Sonstige	55 213 213,38	14,51
Summe Aktien:	231 564 818,71	60,85
2. Anleihen (Emittenten):		
Institute	32 903 336,06	8,65
Sonst. Finanzierungsinstitutionen	30 569 122,23	8,03
Unternehmen	12 295 919,04	3,23
Zentralregierungen	4 965 072,53	1,30
Sonstige öffentliche Stellen	468 510,00	0,12
Sonstige	374 990,10	0,10
Summe Anleihen:	81 576 949,96	21,43
3. Zertifikate	30 676 735,19	8,06
4. Investmentanteile	29 453 100,00	7,74
5. Derivate	-2 965,79	0,00
6. Bankguthaben	6 922 934,63	1,82
7. Sonstige Vermögensgegenstände	774 350,56	0,20
II. Verbindlichkeiten		
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-399 229,37	-0,10
III. Fondsvermögen		
	380 566 693,89	100,00

Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						338 509 792,38	88,95
Aktien							
VT5 Acquisition Company (CH1107979838)	Stück	57 290	64 576	7 286	CHF 9,8000	545 460,02	0,14
Coloplast B (DK0060448595)	Stück	32 000	12 000		DKK 1 024,5000	4 407 340,19	1,16
Novo-Nordisk B (DK0060534915)	Stück	52 500		34 500	DKK 762,3000	5 380 217,79	1,41
Orsted (DK006094928)	Stück	41 000	18 000		DKK 833,6000	4 594 689,79	1,21
2MX Organic (FR0014000T90)	Stück	202 597			EUR 9,8790	2 001 455,76	0,53
Accor Acquisition Co. Unit (FR0014003PZ3)	Stück	280 000			EUR 9,7655	2 734 340,00	0,72
Air Liquide (FR0000120073)	Stück	5 000	5 000		EUR 158,7200	793 600,00	0,21
Allianz (DE0008404005)	Stück	25 000	5 000		EUR 217,2000	5 430 000,00	1,43
Aurubis (DE0006766504)	Stück	31 000		4 000	EUR 109,7500	3 402 250,00	0,89
BASF Reg. (DE000BASF111)	Stück	35 000			EUR 52,8600	1 850 100,00	0,49
BNP Paribas (FR0000131104)	Stück	40 000			EUR 52,5700	2 102 800,00	0,55
BRAIN Biotech (DE0005203947)	Stück	77 586		15 414	EUR 8,6400	670 343,04	0,18
Carl Zeiss Meditec (DE0005313704) ⁶⁾	Stück	26 000			EUR 147,3500	3 831 100,00	1,01
Cherry (DE000A3CRRN9)	Stück	32 837		1 363	EUR 15,6000	512 257,20	0,13
CTP (NL00150006R6)	Stück	183 000	183 000		EUR 14,7500	2 699 250,00	0,71
Deutsche Post Reg. (DE0005552004)	Stück	72 800		7 200	EUR 44,1700	3 215 576,00	0,84
ENCAVIS (DE0006095003)	Stück	360 000			EUR 19,0000	6 840 000,00	1,80
EssilorLuxottica (FR0000121667)	Stück	11 200	11 200		EUR 168,1400	1 883 168,00	0,49
European Healthcare Acq.+ Grow Cl.A (NL0015000K10)	Stück	190 466	190 466		EUR 9,6000	1 828 473,60	0,48
flatexDEGIRO (DE000FTG1111)	Stück	135 000	135 000		EUR 18,7400	2 529 900,00	0,66
GAG Immobilien pref. (DE0005863534)	Stück	57 967	200		EUR 115,0000	6 666 205,00	1,75
I2PO Cl.A (FR0014004J15)	Stück	279 999			EUR 9,7000	2 715 990,30	0,71
Infineon Technologies Reg. (DE0006231004)	Stück	140 000			EUR 31,0350	4 344 900,00	1,14
Instone Real Estate Group (DE000A2NBX80)	Stück	16 118	20 000	3 882	EUR 17,0400	274 650,72	0,07
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton (C.R.) (FR0000121014)	Stück	5 850	1 800		EUR 651,5000	3 811 275,00	1,00
Medios (DE000A1MMCC8)	Stück	18 000	20 000	2 000	EUR 29,9000	538 200,00	0,14
OboTech Acquisition Cl.A (LU2334363566)	Stück	390 000			EUR 9,6500	3 763 500,00	0,99
OMV (AT0000743059)	Stück	25 000	25 000		EUR 43,3900	1 084 750,00	0,29
Pacifico Renewables Yield (DE000A2YN371)	Stück	21 480	7 950		EUR 30,6000	657 288,00	0,17
ProSiebenSat.1 Media Reg. (DE000PSM7770) ⁶⁾	Stück	111 100			EUR 11,7800	1 308 758,00	0,34
Shell (GB00BP6MXD84)	Stück	190 000	190 000		EUR 24,8200	4 715 800,00	1,24
Sixt (DE0007231326)	Stück	28 481		4 519	EUR 123,0000	3 503 163,00	0,92
TotalEnergies (FR0000120271)	Stück	78 750			EUR 46,1800	3 636 675,00	0,96
va-Q-tec Reg. (DE0006636681)	Stück	77 000	27 151		EUR 21,0000	1 617 000,00	0,42
VERBIO Vereinigte BioEnergie (DE000A0JL9W6)	Stück	5 000		10 000	EUR 70,3000	351 500,00	0,09
Verbund AG (AT0000746409)	Stück	60 000			EUR 95,9000	5 754 000,00	1,51
Volkswagen Pref. (DE0007664039)	Stück	27 000			EUR 158,8800	4 289 760,00	1,13
Wacker Chemie (DE000WCH8881)	Stück	25 000			EUR 156,7500	3 918 750,00	1,03
Anglo American (GB00B1XZS820)	Stück	123 000			GBP 40,0000	5 800 176,83	1,52
Compass Group (GB00BD6K4575)	Stück	270 000			GBP 16,5740	5 275 540,58	1,39
Fevertree Drinks (GB00BRJ9BJ26)	Stück	62 726		67 274	GBP 17,8424	1 319 403,78	0,35
Reckitt Benckiser Group (GB00B24CGK77)	Stück	69 000			GBP 58,7200	4 776 516,36	1,26
Acq Bure (SE0015657788)	Stück	221 875			SEK 97,5000	2 094 132,98	0,55
RVRC Holding (SE0015962485)	Stück	367 783	68 879		SEK 80,0500	2 849 996,05	0,75
Alibaba Group Holding ADR (US01609W1027)	Stück	15 000	15 000		USD 116,5800	1 571 159,03	0,41
Allegro Merger RIGHT (US01749N1292)	Stück	30 000			USD 0,0001	2,70	0,00
Alphabet Cl.C (US02079K1079)	Stück	1 700		1 100	USD 2 852,8900	4 357 513,93	1,15
Altimar Acquisition III Cl.A (KYG0370U1085)	Stück	94 643			USD 9,7500	829 082,88	0,22
Bank of America Corp. (US0605051046)	Stück	170 000			USD 43,0000	6 567 834,68	1,73
Brigade-M3 European Acquisition Unit (KYG137071158)	Stück	400 000	400 000		USD 9,9150	3 563 342,32	0,94
Bristol-Myers Squibb Co. (US1101221083)	Stück	30 000			USD 73,7200	1 987 061,99	0,52
Catcha Investment Cl.A (KYG1962Y1026)	Stück	142 858			USD 9,7800	1 255 302,10	0,33
Churchill Capital VII Cl.A (US17144M1027)	Stück	142 858			USD 9,7600	1 252 735,02	0,33
Constellation Acquisition Cl.A (KYG2R18K1053)	Stück	50 000			USD 9,8100	440 700,81	0,12
Conx (US2128731039)	Stück	283 019			USD 9,8500	2 504 705,44	0,66
Costco Wholesale Corp. (US22160K1051)	Stück	5 000		5 000	USD 576,4700	2 589 712,49	0,68
Emerson Electric Co. (US2910111044)	Stück	40 000	15 000		USD 98,9800	3 557 232,70	0,93
Estée Lauder Companies, The Cl.A (US5184391044)	Stück	18 900			USD 279,1600	4 740 452,83	1,25
Forest Road Acquisition II Cl.A (US34619V1035)	Stück	54 762			USD 9,7600	480 213,05	0,13
FORTRESS VALUE ACQUIS IV Cl.A (US34964K1088)	Stück	191 667			USD 9,7700	1 682 467,74	0,44
Fortress Value Acquisition III Cl.A (US34964G1076)	Stück	48 214			USD 9,8800	427 991,30	0,11
Freedom Acquisition I Cl.A (KYG3663X1108)	Stück	71 428			USD 9,7700	627 000,50	0,16
FTAC Hera Acquisition Cl.A (KYG3728Y1035)	Stück	47 322			USD 9,7600	414 971,00	0,11
General Electric (US3696043013) ⁶⁾	Stück	23 892	23 892		USD 94,5800	2 030 283,34	0,53

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Las Vegas Sands Corp. (US5178341070)	Stück	50 000	50 000		USD 39,6500	1 781 221,92	0,47
Lowe's Companies (US5486611073)	Stück	17 500			USD 209,4900	3 293 867,92	0,87
Match Group (US5766711070)	Stück	26 000			USD 110,7200	2 586 451,03	0,68
McDonald's Corp. (US5801351017)	Stück	14 000			USD 249,0300	3 132 452,83	0,82
Microsoft Corp. (US5949181045)	Stück	6 000			USD 313,8600	1 691 967,65	0,44
Nasdaq (US6311031081)	Stück	24 000			USD 181,8800	3 921 940,70	1,03
NIKE B (US6541061031)	Stück	32 500			USD 138,5400	4 045 417,79	1,06
Noble Rock Acquisition Cl.A (KYG6546R1011)	Stück	200 000			USD 9,7800	1 757 412,40	0,46
Oyster Enterprises Acquisition Cl.A (US69242M1045)	Stück	200 000			USD 9,7900	1 759 209,34	0,46
Papaya Growth Opportunity Unit (US69882P2011)	Stück	42 553	42 553		USD 10,0100	382 709,37	0,10
Paramount Group (US69924R1086)	Stück	420 000	100 000		USD 10,8700	4 101 886,79	1,08
PayPal Holdings (US70450Y1038)	Stück	46 800	13 800		USD 118,4900	4 982 328,84	1,31
Periphas Capital Partnering Cl.A (US7138951006)	Stück	31 035			USD 24,5000	683 160,38	0,18
Pyrophyte Acquisition Cl.A (KYG7308P1019)	Stück	110 000	230 000	120 000	USD 9,9400	982 389,94	0,26
Semper Paratus Acquisition Cl.A (KYG8028L1077)	Stück	240 000	240 000		USD 9,9500	2 145 552,56	0,56
SVF Investment Cl.A (KYG8601L1023)	Stück	142 857			USD 9,8000	1 257 860,38	0,33
Tastemaker Acquisition Cl.A (US8765451047)	Stück	240 000			USD 9,9000	2 134 770,89	0,56
The Coca-Cola Co. (US1912161007)	Stück	30 000			USD 62,2100	1 676 819,41	0,44
The Music Acquisition Cl.A (US62752R1005)	Stück	35 714			USD 9,7500	312 858,49	0,08
The Procter & Gamble (US7427181091) ⁶⁾	Stück	10 000			USD 154,3900	1 387 151,84	0,36
Thunder Bridge Capital Partners III Cl.A (US88605T1007)	Stück	53 572			USD 9,8000	471 703,14	0,12
Twilio (US90138F1021)	Stück	16 000	16 000		USD 168,6300	2 424 150,94	0,64
TZP Strategies Acquisition Cl.A (KYG915951019)	Stück	47 945			USD 9,7900	421 726,46	0,11
Walt Disney Co. (US2546871060)	Stück	23 000	23 000		USD 140,9600	2 912 920,04	0,77
Waste Management (Del.) (US94106L1098)	Stück	28 700			USD 159,4500	4 111 603,77	1,08
Xylem (US98419M1009)	Stück	50 600	30 000	39 400	USD 88,1000	4 005 265,05	1,05
Verzinsliche Wertpapiere							
0,1250 % African Development Bank 16/07.10.26 MTN (XS1501560848)	EUR	500			% 96,6290	483 145,00	0,13
0,0000 % Alstom 21/11.01.29 (FR0014001EW8)	EUR	500			% 87,3220	436 610,00	0,11
0,3750 % Berlin Hyp 21/21.04.31 MTN (DE000BHY0SL9)	EUR	500			% 88,8560	444 280,00	0,12
0,3750 % BNP Paribas 20/14.10.27 MTN (FR00140005J1) ³⁾	EUR	500			% 94,2450	471 225,00	0,12
0,3750 % Caixabank 20/18.11.26 MTN (XS2258971071)	EUR	500			% 95,7860	478 930,00	0,13
0,3750 % Credit Agricole London 19/21.10.25 MTN Reg S (XS2067135421) ³⁾	EUR	500			% 97,1820	485 910,00	0,13
0,1000 % Deutsche Pfandbriefbank 21/02.02.26 MTN (DE000A3H2ZX9)	EUR	500			% 95,0840	475 420,00	0,12
0,5000 % Germany 14/15.04.30 INFL (DE001030559) ³⁾	EUR	1 500		500	% 123,7660	2 064 936,70	0,54
1,1000 % Indonesia 21/12.03.33 (XS2280331898)	EUR	430			% 87,2070	374 990,10	0,10
0,7500 % Intesa Sanpaolo 21/16.03.28 MTN (XS2317069685)	EUR	520			% 93,1790	484 530,80	0,13
0,6250 % Intesa Sanpaolo 21/24.02.26 MTN (XS2304664167) ³⁾	EUR	520			% 95,5650	496 938,00	0,13
0,8750 % Iren 19/14.10.29 MTN (XS2065601937)	EUR	500			% 92,1030	460 515,00	0,12
0,2500 % Iren 20/17.01.31 MTN (XS2275029085) ³⁾	EUR	1 000			% 84,6820	846 820,00	0,22
1,2500 % Italy B.T.P. 16/01.12.26 (IT0005210650)	EUR	1 000			% 100,0430	1 000 430,00	0,26
1,3000 % Italy B.T.P. 17/15.05.28 INFL (IT0005246134)	EUR	1 500		1 000	% 115,2070	1 899 705,83	0,50
1,3750 % La Banque Postale 19/24.04.29 MTN (FR0013415692)	EUR	1 000			% 96,5010	965 010,00	0,25
0,2500 % LB Baden-Württemberg 21/21.07.28 MTN (DE000LB2V7C3)	EUR	1 000			% 90,6720	906 720,00	0,24
0,3750 % Medtronic Global Holdings 20/15.10.28 (XS2238789460)	EUR	1 000			% 93,7350	937 350,00	0,25
0,7500 % NatWest Group 19/15.11.25 (XS2080205367)	EUR	1 000			% 98,6880	986 880,00	0,26
5,3750 % Porr 20/Und (XS2113662063)	EUR	2 500			% 92,0990	2 302 475,00	0,61
0,3750 % Raiffeisen Bank International 19/25.09.26 MTN (XS2055627538)	EUR	500			% 94,8560	474 280,00	0,12
0,3750 % Red Eléctrica Financiaciones 20/24.07.28 MTN (XS2103013210)	EUR	400			% 95,4510	381 804,00	0,10
0,8750 % Societe Generale 20/22.09.28 Mtn (FR0013536661)	EUR	1 000			% 94,8030	948 030,00	0,25
0,0100 % Sparebanken Vest Boligkredit 20/28.06.27 MTN PF (XS2199484929)	EUR	1 000			% 94,6420	946 420,00	0,25
0,3230 % Sydbank 04/Und. (XS0205055675)	EUR	2 500			% 87,1710	2 179 275,00	0,57
0,8750 % TenneT Holding 19/03.06.30 MTN (XS2002491780)	EUR	1 000			% 94,8990	948 990,00	0,25
3,7500 % Teva Pharmaceutical Industries 21/09.05.27 (XS2406607098) ³⁾	EUR	1 130	1 130		% 94,7750	1 070 957,50	0,28
0,0000 % Unedic 20/25.11.28 MTN (FR0014000667)	EUR	500			% 93,7020	468 510,00	0,12

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
2,1250 % UniCredit 16/24.10.26 MTN (XS1508450688)	EUR	500			% 100,9360	504 680,00	0,13
2,5000 % ZF Europe Finance 19/23.10.27 (XS2010039977)	EUR	1 100			% 91,1440	1 002 584,00	0,26
2,0000 % ZF Finance 21/06.05.27 MTN Reg S (XS2338564870)	EUR	500			% 90,2560	451 280,00	0,12
13,6250 % Bank of Scotland 91/und. (GB0000394915) ..	GBP	1 000			% 233,0000	2 746 831,71	0,72
5,6250 % NatWest Markets 02/und. MTN (XS0154144132)	GBP	500			% 107,9520	636 321,84	0,17
1,5060 % AEGON 95/und. (NL0000120004)	NLG	3 000			% 96,7975	1 317 743,71	0,35
8,1510 % Dresdner Funding Tr I 99/30.06.31 Reg S (XS009772965)	USD	1 000			% 126,1470	1 133 396,23	0,30
0,1000 % European Bank for Rec. & Dev.20/20.11.30 INFL (XS2259635170)	USD	1 000			% 110,0000	1 067 820,31	0,28
4,7500 % ZF North America Capital 15/29.04.25 Reg S (USU98737AC03)	USD	2 000			% 99,6235	1 790 179,69	0,47
Verbriefte Geldmarktinstrumente							
0,1717 % AEGON 04/und. (NL0000116150)	EUR	3 500			% 88,6690	3 103 415,00	0,82
1,2280 % American International Group 07/15.03.67 MTN (XS0291642154)	EUR	650			% 93,9245	610 509,25	0,16
0,8500 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974)	EUR	1 000			% 88,7950	887 950,00	0,23
0,2960 % AXA 04/und. MTN (XS0203470157)	EUR	1 000			% 87,5850	875 850,00	0,23
1,2650 % Banco Santander 04/Und. (XS0202197694) ³⁾	EUR	1 500			% 81,0350	1 215 525,00	0,32
0,5000 % Caixabank 21/09.02.29 MTN (XS2297549391)	EUR	500			% 91,2890	456 445,00	0,12
0,1580 % Deutsche Postbank Funding Trust I 04/und. pref. (DE000A0DEN75)	EUR	3 750	2 500		% 86,4280	3 241 050,00	0,85
0,2480 % Deutsche Postbank Funding Trust III 05/und. pref. (DE000A0D24Z1)	EUR	5 000			% 86,4410	4 322 050,00	1,14
3,2500 % DIC Asset 17/11.07.22 (DE000A2GSCV5)	EUR	1 900			% 100,3280	1 906 232,00	0,50
1,7070 % Ethias Vie 05/und. (BE0930906947)	EUR	500	500		% 94,2555	471 277,50	0,12
0,0000 % LB Baden-Württemberg 00/17.01.30 MTN (XS0105748205)	EUR	2 000			% 99,6700	1 993 400,00	0,52
1,3150 % NIBC Bank 06/Und. (XS0249580357)	EUR	1 500			% 79,0420	1 185 630,00	0,31
4,0000 % Vossloh 21/Und. (DE000A3H2VA6)	EUR	700			% 103,4830	724 381,00	0,19
0,4960 % AEGON 96/und. (NL0000120889)	NLG	3 835			% 89,2790	1 553 675,23	0,41
1,4250 % AEGON 96/und. (NL0000121416)	NLG	1 000			% 93,2810	423 290,72	0,11
1,8920 % AEGON 04/und. (NL0000116168)	USD	800			% 88,1420	633 545,37	0,17
1,9440 % AXA 04/und. MTN (XS0185672291)	USD	1 000			% 88,9800	799 460,92	0,21
1,7840 % Bank of America 10/15.10.30 MTN (US06048WEE66)	USD	1 880			% 72,1060	1 217 962,98	0,32
1,7960 % Bank of Nova Scotia 13/29.07.33 (US064159CP95)	USD	1 000			% 68,6395	616 707,10	0,16
1,5747 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403)	USD	2 000			% 78,8640	1 417 142,86	0,37
0,2500 % CW Bank of Australia 86/und. (GB0008424284)	USD	4 000			% 92,0520	3 308 247,98	0,87
0,9294 % DNB Bank 86/und. (GB0040940875)	USD	1 000	1 000		% 76,1910	684 555,26	0,18
0,5000 % Hongkong & Shanghai Banking 86/und. S.3 (GB0004355490)	USD	2 000			% 81,7350	1 468 733,15	0,39
1,7497 % HSBC Bank 85/und. (XS0015190423)	USD	1 000			% 82,1500	738 095,24	0,19
2,4530 % NIBC Bank 05/und. MTN (XS0215294512) ..	USD	2 500	1 000		% 79,9240	1 795 238,10	0,47
1,8090 % Standard Chartered 06/und. Reg S (USG84228AT58)	USD	1 500			% 86,6010	1 167 129,38	0,31
1,6497 % Westpac Banking 86/und (GB0009573998) ³⁾	USD	6 000	3 000		% 81,2270	4 378 814,02	1,15
Zertifikate							
Soc. Generale/Equity Basket 23.12.22 TrackerCert. (DE000SG2CLO6)	Stück	42 000			EUR 157,2500	6 604 500,00	1,74
UBS London/Equity Basket 23.12.22 TrackerCert. (CH0575775371)	Stück	75 000	25 000		EUR 104,0900	7 806 750,00	2,05
XTrackers ETC/Gold 21.05.80 (DE000A2T5DZ1)	Stück	612 913		220 000	EUR 26,5380	16 265 485,19	4,27

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						4 074 835,48	1,07	
Verbriefte Geldmarktinstrumente								
1,1491 % HSB Group 97/15.07.27 (US40428NAC39) . . .	USD	4 000			%	90,7448	3 261 268,54	0,86
0,3125 % Standard Chartered 85/und. S.3 (XS0010159159)	USD	1 000	1 000		%	90,5500	813 566,94	0,21
Nicht notierte Wertpapiere						1 233 876,00	0,32	
Verzinsliche Wertpapiere								
3,0000 % Jefferies Group 17/13.12. MTN (XS1725887944)	EUR	1 200			%	102,8230	1 233 876,00	0,32
Investmentanteile						29 453 100,00	7,74	
Gruppeneigene Investmentanteile (inkl. KVG-eigene Investmentanteile)						18 399 500,00	4,84	
Xtrackers MSCI EM Asia Swap UCITS ETF 1C (LU0292107991) (0,450%)	Stück	350 000	200 000		EUR	52,5700	18 399 500,00	4,84
Gruppenfremde Investmentanteile						11 053 600,00	2,90	
Lyxor Core MSCI Japan (DR) UCITS ETF (LU1781541252) (1,350%)	Stück	800 000			EUR	13,8170	11 053 600,00	2,90
Summe Wertpapiervermögen						373 271 603,86	98,08	
Derivate								
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen								
Derivate auf einzelne Wertpapiere						-856 386,00	-0,23	
Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen / Verbindlichkeiten)								
Optionsrechte auf Aktien								
Call Carl Zeiss Meditec 06/2022 Strike 200,00 (EURX) . . .	Stück	-13 000			EUR	0,5750	-7 475,00	0,00
Call ProSiebenSat.1 Media Reg. 06/2022 Strike 16,00 (EURX)	Stück	-111 100			EUR	0,0300	-3 333,00	0,00
Put Alstom 06/2022 Strike 26,00 (EURX)	Stück	-150 000			EUR	4,8950	-734 250,00	-0,19
Put Wacker Chemie 04/2022 Strike 120,00 (EURX)	Stück	-16 000			EUR	0,5000	-8 000,00	0,00
Call General Electric 06/2022 Strike 115,00 (USS)	Stück	-23 800			USD	0,4100	-8 767,30	0,00
Call The Procter & Gamble 04/2022 Strike 150,00 (USS) . . .	Stück	-5 000			USD	4,7600	-21 383,65	0,00
Put Baxter International 08/2022 Strike 75,00 (USS)	Stück	-28 000			USD	2,8000	-70 440,25	-0,02
Put Blackstone 09/2022 Strike 110,00 (USS)	Stück	-22 900			USD	5,6300	-115 837,38	-0,03
Put General Electric 06/2022 Strike 90,00 (USS)	Stück	-25 600			USD	3,7400	-86 023,36	-0,02
Put Las Vegas Sands Corp. 06/2022 Strike 38,00 (USS) . . .	Stück	-60 500			USD	2,6800	-145 678,35	-0,04
Put Nextera Energy Inc. 06/2022 Strike 80,00 (USS)	Stück	-31 600			USD	1,8500	-52 524,71	-0,01
Put The Procter & Gamble 04/2022 Strike 130,00 (USS) . .	Stück	-10 000			USD	0,0200	-179,69	0,00
Put Twilio 09/2022 Strike 130,00 (USS)	Stück	-8 000			USD	9,5500	-68 643,31	-0,02
Wertpapier-Optionsscheine								
Optionsscheine auf Aktien								
2MX Organic 16.11.25 (FR0014000TB2)	Stück	202 597			EUR	0,1300	26 337,61	0,01
Accor Acquisition 03.06.23 WRT (FR0014003QK3)	Stück	280 000			EUR	0,1500	42 000,00	0,01
EHC 16.11.26 (NL0015000K28)	Stück	63 489	63 489		EUR	0,2550	16 189,70	0,00
I2PO Cl.B 21.07.26 (FR0014004JF6)	Stück	279 999			EUR	0,1500	41 999,85	0,01
OboTech Acquisition 30.04.26 (LU2334364374)	Stück	130 000			EUR	0,3000	39 000,00	0,01
Altimar Acquisition 31.12.28 Cl.A (KYG0370U1168)	Stück	23 660			USD	0,5100	10 841,51	0,00
Catcha Investment 31.12.27 Cl.A (KYG1962Y1109)	Stück	47 619			USD	0,2500	10 696,09	0,00
Chp Merg.Corp. Wts24 (US12558Y1148)	Stück	140 845			USD	0,1487	18 817,30	0,01
CHURCHILL CAPITAL CORP VII-A 29.02.28 (US17144M1100)	Stück	28 571			USD	0,6000	15 402,16	0,00
Constellation Acquisition Cl.A 31.12.27 (KYG2R18K1137)	Stück	16 666			USD	0,3000	4 492,18	0,00
Conx 30.10.27 (US2128731112)	Stück	70 754			USD	0,4200	26 699,62	0,01
Forest Road Acquisition II 15.01.26 (US34619V1118)	Stück	10 952			USD	0,4600	4 526,43	0,00
Fortress Value Acquisition 31.12.27 WRT (US34964G1159)	Stück	9 642			USD	0,4302	3 726,86	0,00
Fortress Value Acquisition IV 18.03.28 (US34964K1161) . .	Stück	23 958			USD	0,5205	11 204,08	0,00

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Freedom Acquisition I 31.12.27 Cl.A (KYG3663X1280) . . .	Stück	17 857			USD 0,3010	4 829,25	0,00
FTAC Hera Acquisition 31.12.27 (KYG3728Y1118)	Stück	11 830			USD 0,4448	4 727,74	0,00
Noble Rock Acquisition 31.12.27 (KYG6546R1193)	Stück	66 666			USD 0,2689	16 106,46	0,00
Oyster Enterprises Acquisition 31.12.27 WRT (US69242M1128)	Stück	100 000			USD 0,2400	21 563,34	0,01
Periphas Capital Partnering 10.12.28 WRT (US7138951188)	Stück	7 758			USD 0,7221	5 033,29	0,00
Pyrophyte Acquisition 17.12.23 WRT (KYG7308P1274) . . .	Stück	115 000	115 000		USD 0,4400	45 462,71	0,01
Semper Paratus Acquisition 04.11.26 (KYG8028L1317) . . .	Stück	120 000	120 000		USD 0,2999	32 334,23	0,01
StoneBridge Acquisition 26.02.23 (KYG850941298)	Stück	140 000			USD 0,2401	30 201,26	0,01
SVF Investment Cl.A 31.12.27 (KYG8601L1288)	Stück	28 571			USD 0,5619	14 424,12	0,00
Tastemaker Acquisition 31.12.25 WRT (US8765451120) . . .	Stück	35 714			USD 0,2500	8 022,01	0,00
The Music Acquisition 05.02.28 (US62752R1187)	Stück	17 857			USD 0,1801	2 889,53	0,00
Thunder Bridge Capital Partners 15.02.28 Cl.A (US88605T1189)	Stück	10 714			USD 0,5136	4 944,03	0,00
TZP Strategies Acquisition Cl.A 31.12.27 (KYG915951191)	Stück	15 981			USD 0,2562	3 678,64	0,00
Aktienindex-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						-131 832,50	-0,03
Optionsrechte							
Optionsrechte auf Aktienindices							
Put DAX 40 (Performanceindex) 04/2022 Strike 14000,00 (EURX)	Stück	-140			EUR 118,0000	-16 520,00	0,00
Put Dow Jones Euro STOXX Bank 06/2022 Strike 87,50 (EURX)	Stück	-22 500			EUR 5,1250	-115 312,50	-0,03
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						143 523,86	0,04
Zinsterminkontrakte							
EURO-BOBL JUN 22 (EURX)	EUR	-2 800				107 800,00	0,03
EURO-BUND JUN 22 (EURX)	EUR	-5 000				416 000,00	0,11
US 10YR NOTE JUN 22 (CBT)	USD	10 000				-192 745,09	-0,05
US 2YR NOTE JUN 22 (CBT)	USD	12 000				-97 963,63	-0,03
US 5YR NOTE JUN 22 (CBT)	USD	6 000				-89 567,42	-0,02
Devisen-Derivate						841 728,85	0,22
Devisentermingeschäfte							
EUR/USD FUTURE (CME) JUN 22	USD	71 875				841 728,85	0,22
Bankguthaben und nicht verbriefte Geldmarktinstrumente						6 922 934,63	1,82
Bankguthaben						6 922 934,63	1,82
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	5 255 371,10			% 100	5 255 371,10	1,38
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	58 733,89			% 100	58 733,89	0,02
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Australische Dollar	AUD	4,72			% 100	3,17	0,00
Kanadische Dollar	CAD	114,18			% 100	81,91	0,00
Schweizer Franken	CHF	421,20			% 100	409,21	0,00
Chinesische Renminbi/Yuan	CNY	4 067,51			% 100	576,11	0,00
Britische Pfund	GBP	207 417,92			% 100	244 524,52	0,06
Hongkong Dollar	HKD	88 857,76			% 100	10 196,95	0,00
Japanische Yen	JPY	600,00			% 100	4,41	0,00
Mexikanische Peso	MXN	1 060,57			% 100	47,95	0,00
Russische Rubel	RUB	1 294,00			% 100	14,24	0,00
US Dollar	USD	1 505 856,44			% 100	1 352 970,75	0,36
Südafrikanische Rand	ZAR	6,73			% 100	0,42	0,00

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Sonstige Vermögensgegenstände						774 350,56	0,20
Zinsansprüche	EUR	379 156,33		%	100	379 156,33	0,10
Dividenden-/Ausschüttungsansprüche	EUR	294 593,83		%	100	294 593,83	0,08
Quellensteueransprüche	EUR	92 653,68		%	100	92 653,68	0,02
Sonstige Ansprüche	EUR	7 946,72		%	100	7 946,72	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten						-399 229,37	-0,10
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-396 606,97		%	100	-396 606,97	-0,10
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-2 622,40		%	100	-2 622,40	0,00
Fondsvermögen						380 566 693,89	100,00
Anteilwert						15 692,68	
Umlaufende Anteile						24 251,230	

Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX	=	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
USS	=	American Stock Options Exchange
CBT	=	Chicago Board of Trade (CBOT)
CME	=	Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Options Market Division (IOM)

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 31.03.2022

Australische Dollar	AUD	1,488550	=	EUR	1
Kanadische Dollar	CAD	1,394050	=	EUR	1
Schweizer Franken	CHF	1,029300	=	EUR	1
Chinesische Renminbi/Yuan	CNY	7,060350	=	EUR	1
Dänische Kronen	DKK	7,438500	=	EUR	1
Britische Pfund	GBP	0,848250	=	EUR	1
Hongkong Dollar	HKD	8,714150	=	EUR	1
Japanische Yen	JPY	135,990000	=	EUR	1
Mexikanische Peso	MXN	22,120050	=	EUR	1
Niederländische Gulden	NLG	2,203710	=	EUR	1
Russische Rubel	RUB	90,848650	=	EUR	1
Schwedische Kronen	SEK	10,330200	=	EUR	1
US Dollar	USD	1,113000	=	EUR	1
Südafrikanische Rand	ZAR	16,118900	=	EUR	1

Fußnoten

- 3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 8 677 469,44.
6) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise Gegenstand eines Stillhaltergeschäfts in Wertpapieren (Verkauf einer Kaufoption).

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------------	--------------------------	-----------------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

Montana Aerospace (CH1110425654)	Stück		50 000
alstria office REIT (DE000A0LD2U1)	Stück		150 000
Covestro (DE0006062144)	Stück		63 000
DFV Deutsche Familienversicherung (DE000A2NBVD5)	Stück		39 575
MTU Aero Engines Reg. (DE000A0D9PT0)	Stück	6 000	16 000
Pernod-Ricard (C.R.) (FR0000120693)	Stück		24 000
Shell (GB00B03MLX29)	Stück		190 000
Teamviewer (DE000A2YN900)	Stück		55 000
Equinor (NO0010096985)	Stück		78 300
Blockchain Coinvestors Acquisition (KYG117651235)	Stück	8 616	8 616
Capstar Special Purpose Acquisition (US14070Y1010)	Stück		231 818
CHP Merge (US12558Y1064)	Stück		281 691
ContextLogic (US21077C1071)	Stück		298 981
European Sustainable Growth Acquisition Cl.A (KYG3194F1090)	Stück		97 509
Gores Metropolis II Cl.A (US3828731071)	Stück		39 612
Investindustrial Acquisition Cl.A (KYG4771L1059)	Stück		196 716
M3-Brigade Acquisition II (US5538001034)	Stück		157 738
Pyrophyte Acquisition Unit (KYG7308P1191)	Stück	230 000	230 000
Semper Paratus Acquisition Unit (KYG8028L1234)	Stück	240 000	240 000
Stonebridge Acquisition Cl.A (KYG850941033)	Stück		280 000
Supernova Partners Acquisition Company II Unit (KYG8T86C1136)	Stück		44 166

Verzinsliche Wertpapiere

0,2500 % AT & T 19/04.03.26 (XS2051361264)	EUR		500
0,0000 % Cie Gén. Etablissements Michelin 20/02.11.28 (FR0014000D31)	EUR		300
0,2500 % France O.A.T. 13/25.07.24 INFL (FR0011427848)	EUR		500
3,1000 % Italy B.T.P. 11/15.09.26 INFL (IT0004735152)	EUR		1 000
0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/29.07.26 MTN (DE000LB2CLH7)	EUR		300
1,8000 % Spain 13/30.11.24 INFL (ES00000126A4)	EUR		1 500
0,2000 % Swedbank 21/12.01.28 MTN (XS2282210231)	EUR		1 000
0,0100 % UBS (London Branch) 21/29.06.26 MTN (XS2358287238)	EUR		530

Verbriefte Geldmarktinstrumente

0,0000 % Crédit Agricole 05/und (FR0010161026)	EUR		500
0,6020 % Credit Logement 06/und. (FR0010301713)	EUR		4 500
3,7500 % Deutsche Postbank Funding Trust II 04/und. pref. (DE000A0DHUM0)	EUR		500
0,1530 % RZB Finance (Jersey) III 04/und. (XS0193631040)	EUR		2 100
2,7416 % American International Group 07/15.03.67 MTN (XS0291641420)	GBP		2 500
0,0000 % Deutsche Bank 96/15.10.21 (DE0001343101)	ITL		1 000 000

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------------	--------------------------	-----------------------------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verbriefte Geldmarktinstrumente

1,4079 % Crédit Agricole 07/und. Reg S (USF22797FJ25)	USD		1 600
--	-----	--	-------

Nicht notierte Wertpapiere

Aktien

Deutsche Industrie REIT (DE000A2G9LL1)	Stück		80 000
Deutsche Industrie REIT (DE000A3MQCJ0)	Stück	80 000	80 000

Investmentanteile

Gruppeneigene Investmentanteile (inkl. KVG-eigene Investmentanteile)

Xtrackers II iBoxx Eurz. Gov.Bd Y.Pl. UCITS ETF 1D (LU0962071741) (0,050%)	Stück		34 000
---	-------	--	--------

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumina der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

	Zugänge	Abgänge	
Optionsscheine			
Wertpapier-Optionsscheine			
Optionsscheine auf Aktien			
VT5 Acquisition Company 15.12.23 (CH1108008082)	Stück	21 525	21 525
Capstar Special Purpose Acquisition 09.07.27 WRT (US14070Y1192)	Stück		15 909
European Sustainable Growth Acq. Cl.A 31.12.27 (KYG3194F1173)	Stück		50 000
M3-Brigade Acquisition II 31.12.27 (US5538001117)	Stück		52 579
			Volumen in 1000
Terminkontrakte			
Zinsterminkontrakte			
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: US 10YR NOTE DEC 21, US 10YR NOTE MAR 22)		EUR	16 918
Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO-BOBL MAR 22, EURO-BUND DEC 21, EURO-BUND MAR 22, EURO-SCHATZ MAR 22)		EUR	31 586
Devisentermingeschäfte			
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EUR/USD FUTURE (CME) MAR 22)		EUR	72 294
Optionsrechte			
Wertpapier-Optionsrechte			
Optionsrechte auf Aktien			
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswerte: Carl Zeiss Meditec)		EUR	1 940
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswerte: Aurubis, Equinor)		EUR	1 973
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: Activision Blizzard, Alibaba Group Holding ADR, ASML Holding, BEFESA, Berkshire Hathaway Cl.B (new), flatexDEGIRO, MTU Aero Engines Reg., Nextera Energy Inc., OMV, Orsted, Partners Group Holding Reg., PayPal Holdings, Veolia Environnement, Welltower REIT, Wheaton Precious Metals)		EUR	30 022
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate			
Optionsrechte auf Aktienindices			
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: DAX 40 (Performanceindex))		EUR	172 500
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: DAX 40 (Performanceindex))		EUR	161 000
Optionsrechte auf Zins-Derivate			
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte			
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: EURO-BUND MAR 22)		EUR	2 475

Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes)

	Volumen in 1000
unbefristet	EUR 45 942
Gattung: Lyxor Core MSCI Japan (DR) UCITS ETF (LU1781541252), Xtrackers II iBoxx Eurz. Gov.Bd Y.PI. UCITS ETF 1D (LU0962071741), Xtrackers MSCI EM Asia Swap UCITS ETF 1C (LU0292107991), 0,0000 % Alstom 21/11.01.29 (FR0014001EW8), 0,8500 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974), 1,2650 % Banco Santander 04/Und. (XS0202197694), 0,3750 % BNP Paribas 20/14.10.27 MTN (FR00140005J1), 0,3750 % Credit Agricole London 19/21.10.25 MTN Reg S (XS2067135421), 0,1000 % Deutsche Pfandbriefbank 21/02.02.26 MTN (DE000A3H2ZX9), Germany 14/15.04.30 INFL (DE0001030559), 0,6250 % Intesa Sanpaolo 21/24.02.26 MTN (XS2304664167), 0,2500 % Iren 20/17.01.31 MTN (XS2275029085), 0,2500 % LB Baden-Württemberg 21/21.07.28 MTN (DE000LB2V7C3), 0,8750 % TenneT Holding 19/03.06.30 MTN (XS2002491780), 0,0100 % UBS (London Branch) 21/29.06.26 MTN (XS2358287238), 2,1250 % UniCredit 16/24.10.26 MTN (XS1508450688), 2,5000 % ZF Europe Finance 19/23.10.27 (XS2010039977), 2,0000 % ZF Finance 21/06.05.27 MTN Reg S (XS2338564870), 1,5747 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403), 8,1510 % Dresdner Funding Tr I 99/30.06.31 Reg S (XS0097772965), 1,8090 % Standard Chartered 06/und. Reg S (USG84228AT58)	

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert: EUR 15 692,68

Umlaufende Anteile: 24 251,230

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände:

Die Bewertung erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft stützt sich hierbei grundsätzlich auf externe Quellen.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen Verwahrstelle und Kapitalverwaltungsgesellschaft abgestimmt sind und sich so weit als möglich auf Marktparameter stützen. Diese Vorgehensweise unterliegt einem permanenten Kontrollprozess. Preisauskünfte Dritter werden durch andere Preisquellen, modellhafte Rechnungen oder durch andere geeignete Verfahren auf Plausibilität geprüft.

Die in diesem Bericht ausgewiesenen Anlagen werden in geringfügigem Umfang zu abgeleiteten Verkehrswerten bewertet.

Für die Investmentanteile sind in der Vermögensaufstellung in Klammern die aktuellen Verwaltungsvergütungs-/Kostenpauschalsätze zum Berichtsstichtag für die im Wertpapiervermögen enthaltenen Sondervermögen aufgeführt. Das Zeichen + bedeutet, dass darüber hinaus ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Da das Sondervermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile („Zielfonds“) hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene des Zielfonds angefallen sein.

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (WpFinGesch.) und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 – Ausweis nach Abschnitt A

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	8 677 469,44	-	-
in % des Fondsvermögens	2,28	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	UBS AG, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	3 430 070,98		
Sitzstaat	Großbritannien		
2. Name	Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 794 570,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
3. Name	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 376 624,46		
Sitzstaat	Frankreich		
4. Name	Credit Suisse Bank (Europe) S.A., Madrid		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 215 525,00		
Sitzstaat	Spanien		
5. Name	Barclays Bank Ireland PLC, Dublin		
Bruttovolumen offene Geschäfte	477 825,00		
Sitzstaat	Irland		
6. Name	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	194 364,00		
Sitzstaat	Frankreich		
7. Name	BNP Paribas S.A., Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	188 490,00		
Sitzstaat	Frankreich		
8. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

9. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

10. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

3. Art(en) von Abwicklung und Clearing

(z.B. zweiseitig, dreiseitig, zentrale Gegenpartei)	zweiseitig	-	-
---	------------	---	---

4. Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
über 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	8 677 469,44	-	-

5. Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten

	Art(en):		
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	5 603 626,41	-	-
Aktien	3 908 955,95	-	-
Sonstige	1 095 198,20	-	-

Qualität(en):			
Dem Fonds werden – soweit Wertpapier-Darlehensgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte oder Geschäfte mit OTC-Derivaten (außer Währungstermingeschäften) abgeschlossen werden - Sicherheiten in einer der folgenden Formen gestellt:			
- liquide Vermögenswerte wie Barmittel, kurzfristige Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente gemäß Definition in Richtlinie 2007/16/EG vom 19. März 2007, Akkreditive und Garantien auf erstes Anfordern, die von erstklassigen, nicht mit dem Kontrahenten verbundenen Kreditinstituten ausgegeben werden, beziehungsweise von einem OECD-Mitgliedstaat oder dessen Gebietskörperschaften oder von supranationalen Institutionen und Behörden auf kommunaler, regionaler oder internationaler Ebene begebene Anleihen unabhängig von ihrer Restlaufzeit			
- Anteile eines in Geldmarktinstrumente anlegenden Organismus für gemeinsame Anlagen (nachfolgend „OGA“), der täglich einen Nettoinventarwert berechnet und der über ein Rating von AAA oder ein vergleichbares Rating verfügt			
- Anteile eines OGAW, der vorwiegend in die unter den nächsten beiden Gedankenstrichen aufgeführten Anleihen / Aktien anlegt			
- Anleihen unabhängig von ihrer Restlaufzeit, die ein Mindestrating von niedrigem Investment-Grade aufweisen			
- Aktien, die an einem geregelten Markt eines Mitgliedstaats der Europäischen Union oder an einer Börse eines OECD-Mitgliedstaats zugelassen sind oder gehandelt werden, sofern diese Aktien in einem wichtigen Index enthalten sind.			
Die Verwaltungsgesellschaft behält sich vor, die Zulässigkeit der oben genannten Sicherheiten einzuschränken. Des Weiteren behält sich die Verwaltungsgesellschaft vor, in Ausnahmefällen von den oben genannten Kriterien abzuweichen.			
Weitere Informationen zu Sicherheitenanforderungen befinden sich in dem Verkaufsprospekt des Fonds/Teilfonds.			

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Wahrung(en):	EUR; JPY; AUD; GBP; DKK; NZD; CAD; CHF; USD	-	-
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)			
unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
uber 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	10 607 780,56	-	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)*			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	33 145,70	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	16 325,08	-	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-	-
Ertragsanteil Dritter			
absolut	-	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-	-
9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
absolut	-		
10. Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds			
Summe	8 677 469,44		
Anteil	2,32		
11. Die 10 grosten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name	French Republic		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 949 239,74		
2. Name	European Stability Mechanism (ESM)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 394 642,40		

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

3. Name	Finnvera PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	499 760,00		
4. Name	European Investment Bank (EIB)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	375 823,02		
5. Name	Nordrhein-Westfalen, Land		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	365 115,24		
6. Name	Landwirtschaftliche Rentenbank		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	324 530,50		
7. Name	RPT Realty		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	321 229,65		
8. Name	Industrial Logistics Properties Trust		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	321 229,16		
9. Name	LendLease Group		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	321 227,34		
10. Name	EnQuest PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	321 225,16		

12. Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps

Anteil	-
---------------	---

13. Verwahrt begebener Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps (In % aller begebenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps)

gesonderte Konten / Depots	-	-
Sammelkonten / Depots	-	-
andere Konten / Depots	-	-
Verwahrt bestimmt Empfänger	-	-

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

14. Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps		
Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	3	-
1. Name	State Street Bank International GmbH (Custody Operations)	
verwahrter Betrag absolut	5 102 313,87	
2. Name	Bank of New York	
verwahrter Betrag absolut	5 004 154,15	
3. Name	State Street Bank	
verwahrter Betrag absolut	501 312,54	

* Eventuelle Abweichungen zu den korrespondierenden Angaben der detaillierten Ertrags- und Aufwandsrechnung beruhen auf Effekten im Rahmen des Ertragsausgleichs.

Kapitalverwaltungsgesellschaft

DWS Investment GmbH
60612 Frankfurt am Main
Eigenmittel am 31.12.2021: 115,0 Mio. Euro
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
am 31.12.2021: 451,9 Mio. Euro

Aufsichtsrat

Dr. Asoka Wöhrmann
Vorsitzender
DWS Management GmbH
(Persönlich haftende Gesellschafterin der
DWS Group GmbH & Co. KGaA),
Frankfurt am Main

Christof von Dryander
stellv. Vorsitzender
Cleary Gottlieb Steen & Hamilton LLP,
Frankfurt am Main

Hans-Theo Franken
Deutsche Vermögensberatung AG,
Frankfurt am Main

Dr. Alexander Ilgen
Deutsche Bank AG,
Frankfurt am Main

Britta Lehfeldt (bis zum 31.10.2021)
Deutsche Bank AG,
Frankfurt am Main

Dr. Stefan Marcinowski
Ludwigshafen

Prof. Christian Strenger
The Germany Funds,
New York

Elisabeth Weisenhorn (seit dem 10.2.2022)
Portikus Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Gerhard Wiesheu
Teilhaber des Bankhauses
B. Metzler seel. Sohn & Co. KGaA,
Frankfurt am Main

Susanne Zeidler
Frankfurt am Main

Geschäftsführung

Manfred Bauer
Sprecher der Geschäftsführung

Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Management GmbH
(Persönlich haftende Gesellschafterin der
DWS Group GmbH & Co. KGaA),
Frankfurt am Main
Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main
Mitglied des Aufsichtsrates der
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Dirk Görgen

Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Management GmbH
(Persönlich haftende Gesellschafterin der
DWS Group GmbH & Co. KGaA),
Frankfurt am Main
Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main

Stefan Kreuzkamp

Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Management GmbH
(Persönlich haftende Gesellschafterin der
DWS Group GmbH & Co. KGaA),
Frankfurt am Main
Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main
Mitglied des Aufsichtsrates der
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Dr. Matthias Liermann

Mitglied der Geschäftsführung der
DWS International GmbH,
Frankfurt am Main
Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main
Mitglied des Aufsichtsrates der
DWS Investment S.A.,
Luxemburg
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deutsche Treuinvest Stiftung,
Frankfurt am Main

Petra Pflaum

Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main

Verwahrstelle

State Street Bank International GmbH
Briener Straße 59
80333 München
Eigenmittel am 31.12.2020:
2.302,0 Mio. Euro
(im Sinne von Artikel 72 der Verordnung (EU)
Nr. 575/2013 (CRR))
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital am
31.12.2020: 109,4 Mio. Euro

**Gesellschafter der
DWS Investment GmbH**

DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main



DWS Investment GmbH
60612 Frankfurt am Main
Tel.: +49 (0) 69-910-12371
Fax: +49 (0) 69-910-19090
www.dws.de